

华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资 基金

2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 1 月 24 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 6 月 19 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2018 年 6 月 19 日开始计算。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 华泰柏瑞量化智慧混合 |
| 基金主代码 | 001244 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 6 月 3 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 310,546,384.78 份 |
| 投资目标 | 利用定量投资模型，在有效控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | <p>本基金投资策略如下：</p> <p>1、股票投资策略 本基金主要通过定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。但在极端市场情况下，为保护投资者的本金安全，股票资产比例可降至 0%。</p> <p>2、固定收益资产投资策略 本基金固定收益资产投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>3、资产支持证券投资策略 在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利</p> |

| | | |
|-----------------|---|-----------------|
| | <p>率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。</p> <p>4、权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。</p> <p>5、其他金融衍生工具投资策略 在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。</p> | |
| 业绩比较基准 | 95%*中证 500 指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后） | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华泰柏瑞量化智慧混合 A | 华泰柏瑞量化智慧混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 001244 | 006104 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 261,802,718.41 份 | 48,743,666.37 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日） | |
|-----------------|---------------------------------------|---------------|
| | 华泰柏瑞量化智慧混合 A | 华泰柏瑞量化智慧混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | -3,591,071.30 | -780,517.11 |
| 2. 本期利润 | 6,068,015.87 | 1,047,158.37 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0231 | 0.0208 |
| 4. 期末基金资产净值 | 420,724,884.94 | 82,102,834.93 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.6070 | 1.6844 |

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相

关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞量化智慧混合 A

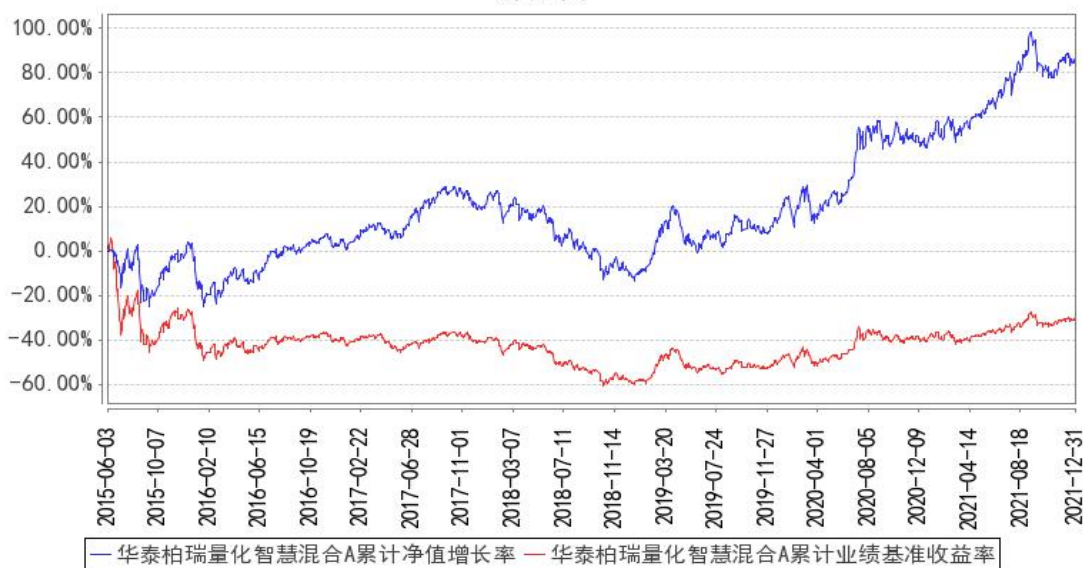
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去三个月 | 1.59% | 0.79% | 3.43% | 0.72% | -1.84% | 0.07% |
| 过去六个月 | 8.44% | 1.00% | 7.72% | 0.91% | 0.72% | 0.09% |
| 过去一年 | 24.65% | 0.99% | 14.83% | 0.92% | 9.82% | 0.07% |
| 过去三年 | 112.27% | 1.28% | 72.29% | 1.31% | 39.98% | -0.03% |
| 过去五年 | 82.39% | 1.24% | 17.27% | 1.27% | 65.12% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 87.15% | 1.47% | -30.20% | 1.61% | 117.35% | -0.14% |

华泰柏瑞量化智慧混合 C

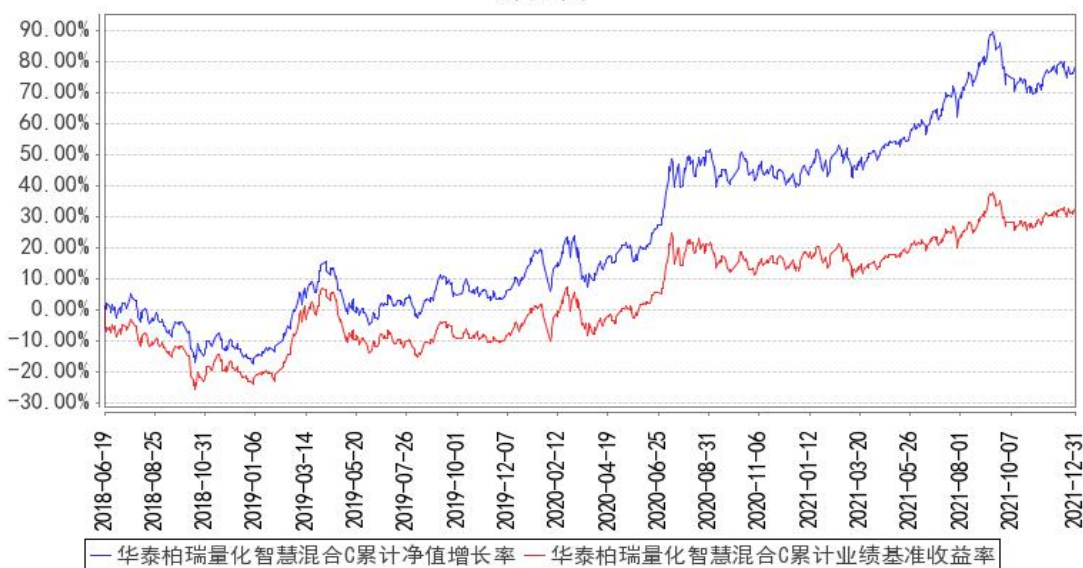
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 1.52% | 0.79% | 3.43% | 0.72% | -1.91% | 0.07% |
| 过去六个月 | 8.31% | 1.00% | 7.72% | 0.91% | 0.59% | 0.09% |
| 过去一年 | 24.35% | 0.99% | 14.83% | 0.92% | 9.52% | 0.07% |
| 过去三年 | 111.86% | 1.28% | 72.29% | 1.31% | 39.57% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 78.64% | 1.31% | 41.26% | 1.34% | 37.38% | -0.03% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰柏瑞量化智慧混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华泰柏瑞量化智慧混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：A 级图示日期为 2015 年 6 月 3 日至 2021 年 12 月 31 日。C 级图示日期为 2018 年 6 月 19 日至 2021 年 12 月 31 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 笕篁 | 本基金的基金经理 | 2021 年 9 月 17 日 | - | 7 年 | 美国明尼苏达大学双城分校金融数学硕士，曾任中国金融期货交易所债券事业部助理经理。2016 年 6 月加入华泰柏瑞基 |

| | | | | | |
|-----|---------------|----------------|-----------------|------|--|
| | | | | | 金管理有限公司, 历任量化与海外投资部助理研究员、研究员、高级研究员。2020 年 5 月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月起任华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。 |
| 田汉卿 | 副总经理、本基金的基金经理 | 2015 年 6 月 3 日 | 2021 年 11 月 2 日 | 19 年 | 副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司 (BGI) 担任投资经理, 2012 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司, 2013 年 8 月起任华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金的基金经理, 2013 年 10 月起任公司副总经理, 2014 年 12 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2015 年 3 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金的基金经理的基金经理, 2015 年 3 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2015 年 6 月至 2021 年 11 月任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016 年 5 月起任华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 5 月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月起任华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。本科与研究生毕业于清华大学, MBA 毕业于美国加州大学伯克利分校哈 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|-------|
| | | | | | 斯商学院。 |
|--|--|--|--|--|-------|

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内无下列情况：所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年四季度，市场风格相比三季度有明显变化。三季度在上游资源品供给不足、“能耗双控”等因素的影响下，周期、中小市值板块表现较好；四季度周期品价格在调控之后有明显的回落，前期较为强势的新能源主题呈现震荡，市场行情进一步集中至中小市值、题材板块。9 月 30 日至年底期间，传统行业占比较高的上证 50、沪深 300 分别上涨 2.42%、1.52%；代表成长类的创业板指和科创 50 分别上涨 2.40%和 2.15%；相对估值偏低的中小市值指数中证 500 和中证 1000 分别上涨 3.60%和 8.17%。整体来看市场一方面对政策边际变动比较敏感，另一方面对前期的估值分化有一定的修正。

本报告期内，我们坚持基本面多因子的量化选股策略，结合对市场的研判，采取比较稳健的投资策略。

四季度，一方面新冠病毒新变种传播再一次强化疫情对生产和贸易的抑制，另一方面全球流

动性宽松转向、国内商品价格管控、地产行业风险显露等新变量影响凸显。从市场来看，外部货币政策边际收紧，我国经济增长受压。2022 年，如果要对冲经济下行的压力，我们预期货币政策可能边际宽松。

A 股市场在经历了比较长时间的估值分化的市场环境之后，逐步进入基本面业绩驱动的环境。消费、医药等行业中少数较高估值的板块短期估值上仍有一定的压力；周期等板块的政策扰动集中释放后，可能回归基本面改善的逻辑；新能源等节能环保板块尽管短期已经涨幅较大，但是从我国 2030 节能减排目标看该板块长期空间仍然巨大。我们预计接下来市场将对新一年的政策导向与上市公司年报业绩反应比较敏感，如果市场是理性的话，会切换到性价比相对较好的股票或者板块上。从基本面的角度看，我们对于整体市场不悲观。

量化策略方面，我们预期未来的市场风格可能会更加有利于华泰柏瑞量化模型获取超额收益。从因子表现来看，压抑两年的估值因子出现一定反转，而我们计算的成长因子预期会继续表现良好。市场抱团的龙头股估值已经很高，当前抱团的投资策略也已经比较拥挤。市场将回归基本面，未来大小市值、各行业股票的表现将更加均衡，量化投资全市场选股的优势将得以更好体现。虽然近期市场有一定的反复，但大方向上应该还是比较确定的。

当然，短期市场走势上可能会有一定的波动。原因可能来自全球流动性边际收紧或经济复苏边际降速带来的市场情绪上的影响。但我们认为，当前 A 股市场整体基本面较好，如果出现比较大的波动，会是很不错的买入风格更加均衡的量化基金的机会。

在组合管理方面，本基金还是坚持利用量化选股策略，在有效控制主动投资风险的前提下，力求继续获得超越市场的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞量化智慧混合 A 的基金份额净值为 1.6070 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.59%，同期业绩比较基准收益率为 3.43%，截至本报告期末华泰柏瑞量化智慧混合 C 的基金份额净值为 1.6844 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.52%，同期业绩比较基准收益率为 3.43%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 449,627,207.20 | 88.47 |
| | 其中：股票 | 449,627,207.20 | 88.47 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 9,949,000.00 | 1.96 |
| | 其中：债券 | 9,949,000.00 | 1.96 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 38,793,160.10 | 7.63 |
| 8 | 其他资产 | 9,883,222.16 | 1.94 |
| 9 | 合计 | 508,252,589.46 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 2,924,636.00 | 0.58 |
| B | 采矿业 | 22,611,797.00 | 4.50 |
| C | 制造业 | 294,549,790.96 | 58.58 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,405,713.70 | 2.67 |
| E | 建筑业 | 10,440,512.54 | 2.08 |
| F | 批发和零售业 | 12,045,926.99 | 2.40 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 13,745,160.80 | 2.73 |
| H | 住宿和餐饮业 | 4,608.00 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 26,925,552.30 | 5.35 |
| J | 金融业 | 22,529,563.79 | 4.48 |
| K | 房地产业 | 11,307,134.70 | 2.25 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,901,500.00 | 0.78 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,676,964.78 | 0.53 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,923,291.19 | 0.58 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 934,622.78 | 0.19 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 8,002,019.67 | 1.59 |
| S | 综合 | 698,412.00 | 0.14 |
| | 合计 | 449,627,207.20 | 89.42 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 300573 | 兴齐眼药 | 25,700 | 3,515,760.00 | 0.70 |
| 2 | 600373 | 中文传媒 | 260,200 | 3,216,072.00 | 0.64 |
| 3 | 600325 | 华发股份 | 527,100 | 3,173,142.00 | 0.63 |
| 4 | 603444 | 吉比特 | 7,300 | 3,079,505.00 | 0.61 |
| 5 | 000733 | 振华科技 | 24,700 | 3,069,716.00 | 0.61 |
| 6 | 000959 | 首钢股份 | 507,500 | 2,907,975.00 | 0.58 |
| 7 | 600522 | 中天科技 | 171,400 | 2,906,944.00 | 0.58 |
| 8 | 002736 | 国信证券 | 245,300 | 2,816,044.00 | 0.56 |
| 9 | 603886 | 元祖股份 | 116,700 | 2,748,285.00 | 0.55 |
| 10 | 688368 | 晶丰明源 | 8,500 | 2,720,850.00 | 0.54 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 9,949,000.00 | 1.98 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 9,949,000.00 | 1.98 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 219958 | 21 贴现国债 58 | 100,000 | 9,949,000.00 | 1.98 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元) | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|-------------------|-------------------|----------|---------------|------------|--------------|
| IC2203 | 中证 500 期货 2203 合约 | 12 | 17,533,920.00 | 466,752.00 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | 466,752.00 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | -775,992.00 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | 3,322,312.00 |

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据公募基金相关法规和本基金合同，我们可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。本报告期间基金遇到大额申赎时，我们有使用股指期货套保保持仓位。股指期货贴水时，我们选择保持一定比例的股指期货长仓，获取比较确定的超额收益。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 2,526,203.39 |
| 2 | 应收证券清算款 | 7,229,049.98 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 29,841.89 |
| 5 | 应收申购款 | 98,126.90 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 9,883,222.16 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华泰柏瑞量化智慧混合 A | 华泰柏瑞量化智慧混合 C |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 276,125,995.71 | 68,824,556.63 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 10,925,530.56 | 1,703,954.81 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 25,248,807.86 | 21,784,845.07 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 261,802,718.41 | 48,743,666.37 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-38784638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2022 年 1 月 24 日